

DETERMINACIÓN Y CÁLCULO INTERÉS NOMINAL, INTERESES Y AMORTIZACIÓN APLICABLE A LOS BONOS
Determining and Calculating Bond Nominal Interest, Interest and Amortisation
FECHA DE PAGO / Payment date **17.10.2016**
Periodo de Interés / Interest accrual period
 desde / From **18.07.2016** (incluido) / (included)
 hasta / To **17.10.2016** (excluido) / (excluded)
 plazo / Term 91 días / days

Bonos Serie A	Bonos Serie B	Bonos Serie C
<i>Series A Bonds</i>	<i>Series B Bonds</i>	<i>Series C Bonds</i>
ES0374306001	ES0374306019	ES0374306027

Determinación Tipo Interés Nominal
Nominal Interest Rate Calculation

Euribor 3 meses / 3 Month Euribor	14.07.2016	-0,295%	-0,295%	-0,295%
Margen / Margin		0,180%	0,400%	0,950%
Tipo de Interés Nominal aplicable / Interest Rate		0,000%*	0,105%	0,655%

Bono	Serie	Bono	Serie	Bono	Serie
<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>	<i>Bond</i>	<i>Series</i>
	9.091		285		124
Número de Bonos / N.Bonds					
Nominal / Face value	(Euros)	16.729,76	152.090.248,16	35.035,57	9.985.137,45
				35.028,50	4.343.534,00

Liquidación de Intereses
Interest Payment

 Base / Day count fraction **Act / 360**

Intereses Brutos / Gross	(Euros)	0,000000	0,00	9,299024	2.650,22	57,996493	7.191,57
<i>Interest Retención / Withholding tax</i>	19,00%	0,000000	0,00	1,766815	503,54	11,019334	1.366,40
Neto / Net		0,000000	0,00	7,532209	2.146,68	46,977159	5.825,17

Amortización de Principal
Principal Redemption
Amortización / Redemption
A determinar A determinar **A determinar** A determinar **A determinar** A determinar
To be determined To be determined **To be determined** To be determined **To be determined** To be determined

* El Tipo de Interés Nominal aplicable se ha fijado en el 0,000% debido a que los términos del Folleto y en concreto los apartados II.10 y V.4.2.1 del Folleto Informativo no contemplan la posibilidad de un Tipo de Interés Nominal negativo que pudiera dar lugar a intereses a satisfacer por los tenedores de los Bonos a favor del Fondo.

* The applicable Nominal Interest Rate has been set at 0.000% because the terms of the Prospectus and specifically sections II.10 and V.4.2.1 of the Prospectus do not provide for the possibility of a negative Nominal Interest Rate which might result in interest being payable by Bondholders to the Fund.

C/ Lagasca, 120 -MADRID, SPAIN - Tel. (34) 91 411 84 67 - Fax (34) 91 411 84 68

info@edt-sg.com
www.edt-sg.com